

东方岳灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人定期或不定期投资在不同投资品种的交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理解释并留存记录。

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601230	环旭电子	198,200	15,955,040.00	6.48
2	600319	公用事业	9,200	6,008,000.00	2.31
3	600036	招商银行	395,000	6,709,344.00	2.76
4	601388	工商银行	688,000	5,012,096.00	2.00
5	601818	招商证券	234,400	3,798,000.00	1.53
6	000035	深国商	86,400	3,543,264.00	1.44
7	000041	格力电器	188,100	3,541,420.00	1.43
8	600016	民生银行	632,200	3,280,716.00	1.32
9	600128	交通银行	536,400	3,076,776.00	1.24
10	000007	伊泰股份	114,200	2,936,224.00	1.18

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细		单位：人民币元	
代码	行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	498,413.00	0.24
B	制造业	6,269,307.00	2.52
C	金融业	96,924,792.00	39.60
D	电力、热力、燃气及生产供应业	5,619,360.00	2.26
E	建筑业	6,872,600.00	2.71
F	信息技术业	5,832,728.00	2.31
G	交通过输、仓储和邮政业	9,599,212.00	3.81
H	房地产业	2,267,280.00	0.91
I	医药生物	7,000,042.00	2.78
J	金融业	67,762,122.08	27.03
K	房地产业	9,506,088.00	3.79
L	信息技术业	2,714,430.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	929,300.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	1,428,000.00	0.57
O	国防军工	2,863,060.00	1.15
P	教育	4,160,397.79	1.66
Q	公用事业	971,221.08	0.39
R	文化、体育和娱乐业	369,007.00	0.15
S	合计	154,612,491.08	62.07

注：①上述的任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《东方岳灵活配置混合型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无法定法、违规行为。本基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

5.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细		单位：人民币元		
序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益类		89,419,763.2	7.76
2	中期票据		89,419,763.2	7.76
3	基金类		10,024,000.00	0.89
4	混合类		10,024,000.00	0.89
5	金融债			
6	企业债			
7	资产支持证券			
8	可转债			
9	其他			
10	合计		110,448,467.2	9.74

注：①上述的任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解除日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《东方岳灵活配置混合型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无法定法、违规行为。本基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

5.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细		单位：人民币元			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000193	中航光电	200,000	6,800,000.00	5.78
2	600887	伊泰股份	260,000	6,028,000.00	5.16
3	600849	攀钢钒钛	300,000	5,980,000.00	5.16
4	600039	招商证券	8,000	4,828,000.00	4.22
5	000062	长安汽车	18,000	4,206,000.00	3.62
7	601318	中国平安	60,000	4,110,000.00	3.50
8	600104	上汽集团	120,000	3,768,000.00	3.28
9	002007	华信软件	100,000	3,700,000.00	3.18
10	000001	格力电器	3,000,000	3,000,000.00	2.53

注：①上述的任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解除日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《东方岳灵活配置混合型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无法定法、违规行为。本基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

5.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细		单位：人民币元			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600039	招商证券	176,200	7,461,000.00	1.44
2	600011	华仪电气	167,200	7,384,072.00	1.43
3	601230	环旭电子	6,388,000	5,089,264.00	0.99
4	000034	苏宁云商	526,200	5,081,744.00	1.00
5	000071	比亚迪	1,172,200	6,081,264.00	1.23
6	600741	华讯方舟	3,000,000	6,024,240.00	1.23
7	000088	长电科技	1,040,000	6,269,307.00	1.25
8	601818	招商证券	167,200	6,256,288.00	1.25
9	600016	民生银行	259,600	6,188,656.00	1.25
10	000033	德赛电池	410,000	5,994,700.00	1.18

注：①上述的任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解除日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《东方岳灵活配置混合型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无法定法、违规行为。本基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

基金管理人：东方基金管理有限责任公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23日复核了本报告中财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。



3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期权益类投资收益	-2,692,860.52
2.本期净利润	-6,460,150.13
3.本期基金份额持有人应得净利润	-6,009.08
4.本期基金资产净值	205,707,027.22
5.期末基金份额净值	0.9981

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.86%	1.55%	-1.03%	0.91%	-1.83%	0.64%

3.2.2 自基金成立以来以基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
王蔚华(先生)	基金经理